

深证红利交易型开放式指数证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日
重要提示:基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日
重要提示:基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

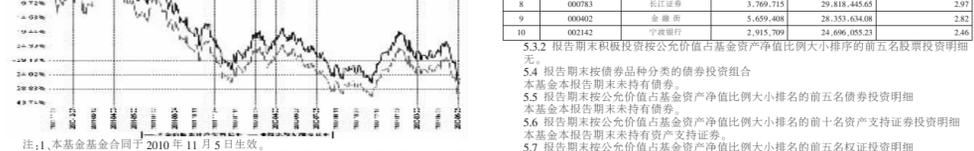
Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 基金管理人, 基金托管人.

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2013年4月1日至2013年6月30日), 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期“已实现收益”指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,“本期利润”为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-③, ②-④.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势图对比图



注:1.本基金基金合同于2010年11月5日生效。
2.根据基金合同约定,本基金建仓期为3个月,截至报告期末,本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定;本基金投资于目标指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%。

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任期起始日期, 任期终止日期, 证券从业资格, 说明. Lists the management team including the fund manager and board members.

4.2 管理人对本报告期内本基金运作遵守信守情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金法》等法律法规和公司内部规定,制定了《公平交易管理办法》。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
本报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.03%,偏离度年化标准差为0.97%,本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)申购赎回的影响;2)成份股票的停牌;3)指数中成份股票的调整。

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 基金管理人, 基金托管人.

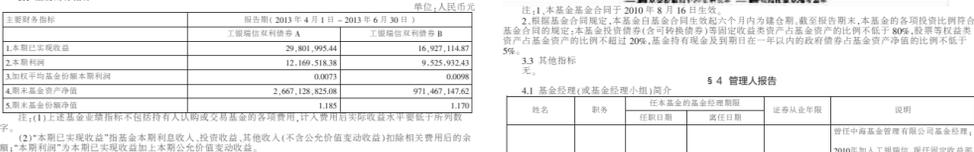
基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日
重要提示:基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2013年4月1日至2013年6月30日), 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期“已实现收益”指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,“本期利润”为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-③, ②-④.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势图对比图



注:1.本基金基金合同于2010年6月16日生效。
2.根据基金合同约定,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同的规定;本基金投资于目标ETF资产占基金资产净值的比例不低于90%,股指期货等权益类资产占基金资产净值的比例不超过20%,基金持有现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任期起始日期, 任期终止日期, 证券从业资格, 说明. Lists the management team for the second fund.

4.2 管理人对本报告期内本基金运作遵守信守情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金法》等法律法规和公司内部规定,制定了《公平交易管理办法》。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
本报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.03%,偏离度年化标准差为0.97%,本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)申购赎回的影响;2)成份股票的停牌;3)指数中成份股票的调整。

2013年二季度,美国持续量化宽松政策,日本同样推出量化宽松政策刺激经济,欧洲债务问题有所缓和,全球资本市场

工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日
重要提示:基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日
重要提示:基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

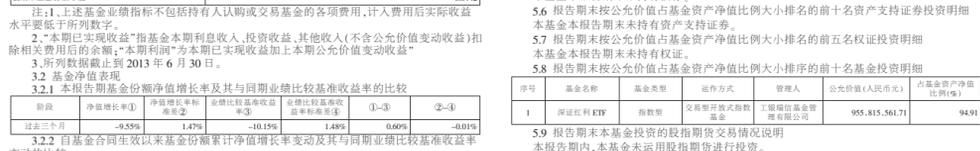
Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 基金管理人, 基金托管人.

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2013年4月1日至2013年6月30日), 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期“已实现收益”指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,“本期利润”为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-③, ②-④.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势图对比图



注:1.本基金基金合同于2010年11月9日生效。
2.根据基金合同约定,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的投资比例符合基金合同的规定;本基金投资于目标ETF资产占基金资产净值的比例不低于90%,股指期货等权益类资产占基金资产净值的比例不超过20%,基金持有现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任期起始日期, 任期终止日期, 证券从业资格, 说明. Lists the management team for the third fund.

4.2 管理人对本报告期内本基金运作遵守信守情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金法》等法律法规和公司内部规定,制定了《公平交易管理办法》。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
本报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.03%,偏离度年化标准差为0.97%,本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)申购赎回的影响;2)成份股票的停牌;3)指数中成份股票的调整。

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 基金管理人, 基金托管人.

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日
重要提示:基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2013年4月1日至2013年6月30日), 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期“已实现收益”指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,“本期利润”为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-③, ②-④.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势图对比图



注:1.本基金基金合同于2010年6月16日生效。
2.根据基金合同约定,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同的规定;本基金投资于目标ETF资产占基金资产净值的比例不低于90%,股指期货等权益类资产占基金资产净值的比例不超过20%,基金持有现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任期起始日期, 任期终止日期, 证券从业资格, 说明. Lists the management team for the fourth fund.

4.2 管理人对本报告期内本基金运作遵守信守情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金法》等法律法规和公司内部规定,制定了《公平交易管理办法》。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
本报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.03%,偏离度年化标准差为0.97%,本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)申购赎回的影响;2)成份股票的停牌;3)指数中成份股票的调整。

2013年二季度,美国持续量化宽松政策,日本同样推出量化宽松政策刺激经济,欧洲债务问题有所缓和,全球资本市场